

申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型  
集合资产管理计划  
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：申万宏源证券资产管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	41

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	42
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	42
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	42
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	42
7.11 投资组合报告附注 .....	42
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	44
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>44</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	45
10.4 基金投资策略的改变 .....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
10.8 其他重大事件 .....	46
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>47</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	47
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>47</b>
12.1 备查文件目录 .....	47
12.2 存放地点 .....	48
12.3 查阅方式 .....	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划		
基金简称	申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券		
基金主代码	970197		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2022 年 11 月 15 日		
基金管理人	申万宏源证券资产管理有限公司		
基金托管人	中国光大银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	633,504,223.43 份		
基金合同存续期	变更为本集合计划后，本集合计划存续期限自本集合计划合同生效之日起 3 年。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。		
下属分级基金的基金简称	申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 A	申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 B	申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 C
下属分级基金的交易代码	970197	970198	970199
报告期末下属分级基金的份额总额	197,076,083.41 份	346,937,674.24 份	89,490,465.78 份

注：本报告所述的“基金”系指按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求完成合同变更后的证券公司大集合资产管理计划申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）。管理人拟向中国证监会申请公募基金管理资格，在取得公募基金管理资格后，管理人将按照相关监管规定将本集合计划注册变更为公募基金。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划在追求本金安全、严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力求为持有人提供超越业绩比较基准的稳健回报，实现集合计划资产长期稳健增值。
投资策略	坚持稳健投资，在严格控制风险的基础上，追求长期持续稳定的合理回报。本集合计划的债券投资策略包括久期偏离策略、类别选择策略、相对价值策略、个券选择策略、信用债投资策略。本集合计划的投资策略还包括国债期货投资策略等。
业绩比较基准	中债-新综合全价（1 年以下）指数收益率
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划，在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、现金管理型集合计划，低于股票型基金、股票型集合计划、混合型基金和混合型集合计划。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		申万宏源证券资产管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙兆军	石立平
	联系电话	021-33389888	010-63639180

电子邮箱	sunzhj@swhysc.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话	95523	95595
传真	-	010-63639132
注册地址	上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层	北京市西城区太平桥大街 25 号 中国光大中心
办公地址	上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层	北京市西城区太平桥大街 25 号 中国光大中心
邮政编码	200031	100033
法定代表人	袁锦	吴利军

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.swhyzcg1.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号 恒奥中心 A 座

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)		
	申万宏源季季优选 3 个月滚 动持有债券 A	申万宏源季季优选 3 个月滚 动持有债券 B	申万宏源季季优选 3 个月滚 动持有债券 C
本期已实现 收益	2,636,465.15	7,188,986.82	1,000,538.76
本期利润	3,243,042.34	9,105,465.58	1,290,531.81
加权平均基 金份额本期 利润	0.0229	0.0247	0.0222
本期加权平 均净值利润 率	2.17%	2.35%	2.12%
本期基金份 额净值增长	2.27%	2.37%	2.15%

率			
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024 年 6 月 30 日)		
期末可供分配利润	10,243,119.95	19,224,396.78	4,286,821.17
期末可供分配基金份额利润	0.0520	0.0554	0.0479
期末基金资产净值	209,509,720.23	369,965,699.56	94,769,916.18
期末基金份额净值	1.0631	1.0664	1.0590
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024 年 6 月 30 日)		
基金份额累计净值增长率	6.35%	6.64%	5.94%

注：(1) 本期已实现收益指本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

(2) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(3) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.46%	0.02%	0.07%	0.01%	0.39%	0.01%
过去三个月	1.12%	0.04%	0.35%	0.01%	0.77%	0.03%
过去六个月	2.27%	0.03%	0.84%	0.01%	1.43%	0.02%
过去一年	3.89%	0.03%	1.61%	0.01%	2.28%	0.02%
自基金合同生效起至今	6.35%	0.03%	2.77%	0.01%	3.58%	0.02%

申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 B

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.48%	0.02%	0.07%	0.01%	0.41%	0.01%
过去三个月	1.18%	0.04%	0.35%	0.01%	0.83%	0.03%
过去六个月	2.37%	0.03%	0.84%	0.01%	1.53%	0.02%
过去一年	4.09%	0.03%	1.61%	0.01%	2.48%	0.02%
自基金合同生效起至今	6.64%	0.03%	2.82%	0.01%	3.82%	0.02%

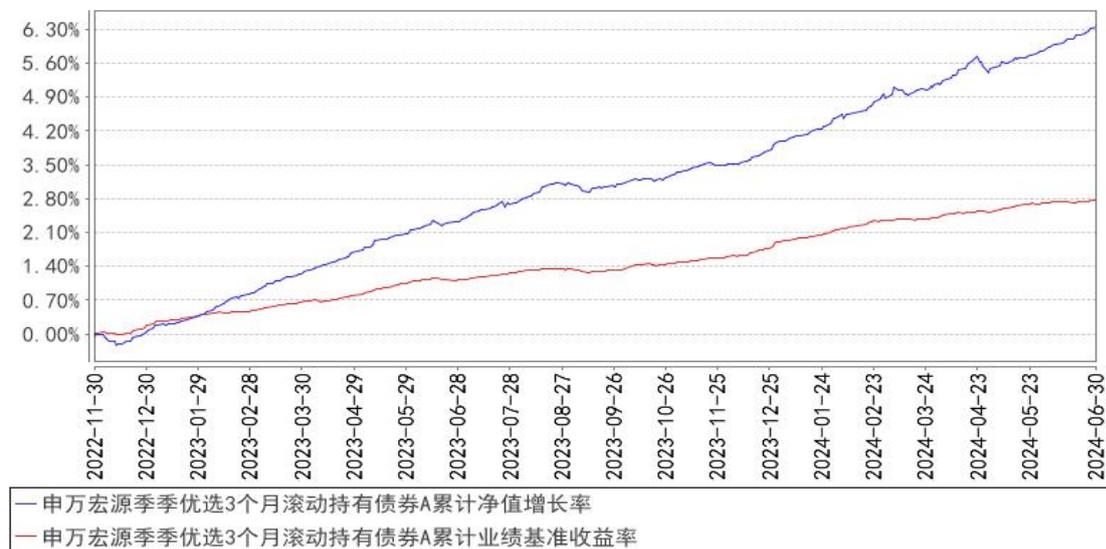
申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.44%	0.02%	0.07%	0.01%	0.37%	0.01%
过去三个月	1.07%	0.03%	0.35%	0.01%	0.72%	0.02%
过去六个月	2.15%	0.03%	0.84%	0.01%	1.31%	0.02%
过去一年	3.64%	0.03%	1.61%	0.01%	2.03%	0.02%
自基金合同生效起至今	5.94%	0.03%	2.77%	0.01%	3.17%	0.02%

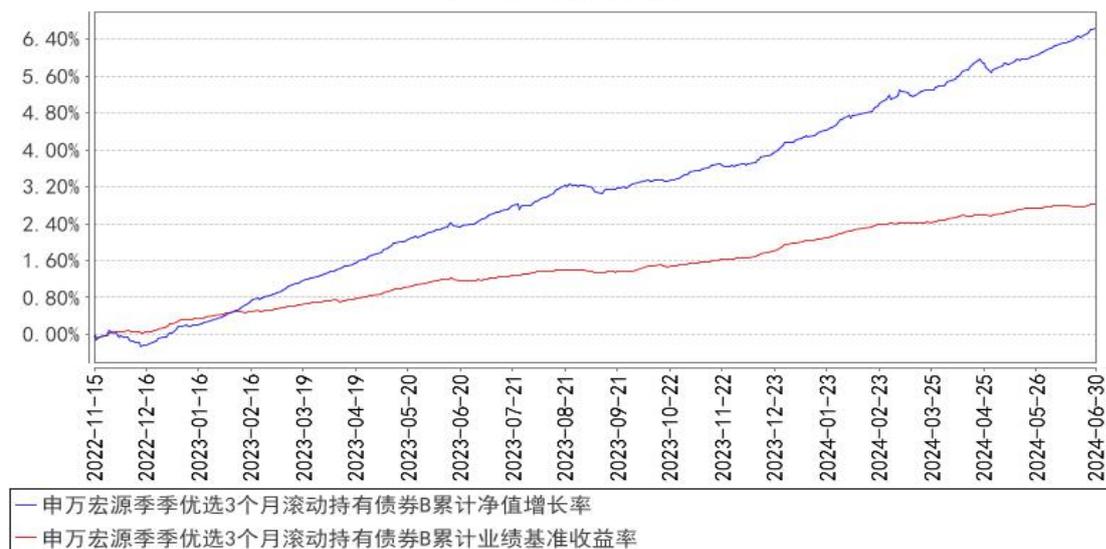
注：本集合计划合同变更生效日为 2022 年 11 月 15 日，申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 A 份额和申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 C 份额首次确认日是 2022 年 11 月 30 日。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

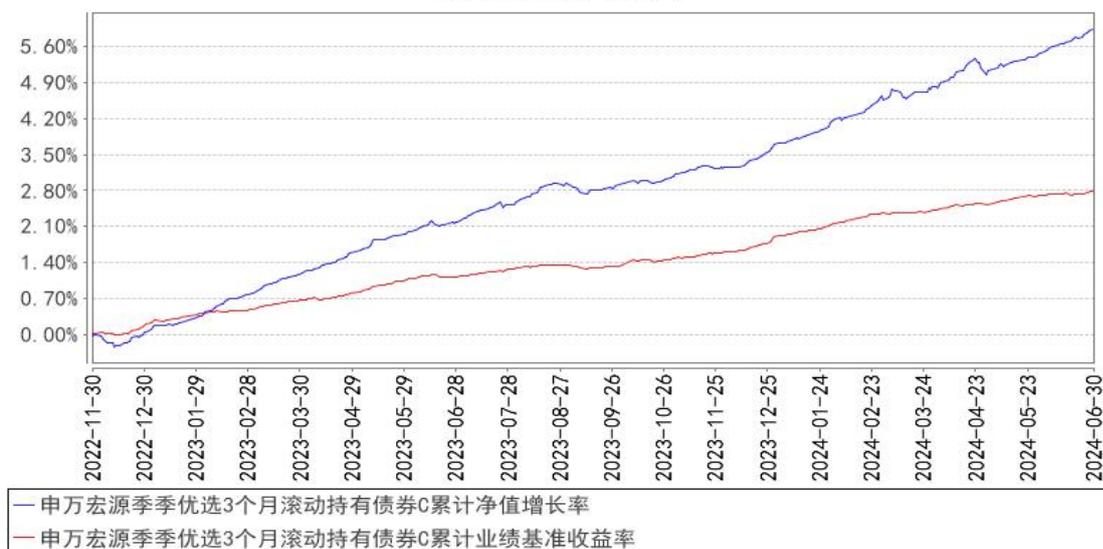
申万宏源季季优选3个月滚动持有债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



申万宏源季季优选3个月滚动持有债券B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



申万宏源季季优选3个月滚动持有债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 A 份额和申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 C 份额首次确认日是 2022 年 11 月 30 日。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

申万宏源证券资产管理有限公司（以下简称“申万宏源资管”或“公司”）正式成立于 2022 年 12 月 20 日，是申万宏源证券有限公司（以下简称“申万宏源证券”或“母公司”）的全资子公司，公司注册资本 25 亿元，是国内目前较大的证券资产管理公司之一。

申万宏源资管已取得《经营证券期货业务许可证》（流水号：000000059581），具备证券资产管理业务资格。

截至 2024 年 6 月 30 日，集合资产管理计划管理人共管理 6 只公募集合资产管理计划，分别为申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划、申万宏源灵通快利短期债券型集合资产管理计划、申万宏源天添利货币型集合资产管理计划、申万宏源天天增货币型集合资产管理计划、申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划、申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
季程	本基金的	2019 年 8	-	10 年	毕业于新加坡南洋理工大学，金融学硕士，

	基金经理	月 9 日			曾任职于申银万国证券股份有限公司资产管理事业部，申万宏源证券有限公司资产管理事业部，现任申万宏源证券资产管理有限公司公募投资部投资经理，具有多年资产管理工作经验。已取得投资主办人执业证书，证书编号为：Z0140824030008，并已取得基金从业资格，证书编号为：F4530000002664，不存在其他兼职情况，且最近三年无被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚的经历。
丁杰科	本基金的基金经理	2020 年 1 月 3 日	-	16 年	经济学和法学双学士，产业经济学硕士，中级经济师。先后就职于交银施罗德基金、中国农业银行金融市场部、申万菱信基金、申万宏源证券有限公司资产管理事业部，现任申万宏源证券资产管理有限公司公募投资部投资经理，拥有多年债券交易和投资经验，担任过货币、债券，股债混合等多种类型基金产品的基金经理。不存在其他兼职情况。已取得投资主办人执业证书，证书编号为：Z0140824030009，并已取得基金从业资格，证书编号为：F4530000003495，且最近三年无被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚的经历。
叶蕊	本基金的基金经理	2023 年 12 月 27 日	-	15 年	金融学硕士，具有多年固定收益类资产管理经验。曾任职于长盛基金管理有限公司研究交易岗、中信建投证券股份有限公司固定收益部投资岗、申万宏源证券有限公司资产管理事业部固定收益部负责人，现任申万宏源证券资产管理有限公司公募投资部负责人。已取得证券执业证书，证书编号为：Z0140124030111，并已取得基金从业资格并在基金业协会登记为投资经理，证书编号为：F4530000003408，不存在其他兼职情况，且最近三年无被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚的经历。

注：1. 任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；鉴于本集合计划由证券公司大集合资产管理计划变更而来，若投资经理在变更生效日（即基金合同生效日）前已担任本集合计划投资经理的，则任职日期为该投资经理首次担任本集合计划投资经理之日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》等有关法律法规及《申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》、《申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》等有关本集合计划法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立并健全了有效的公平交易执行体系，同时建立了科学规范的投资决策体系，采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现；通过建立层级完备的公司股票池和债券库，完善各类具体资产管理业务组织结构，规范各项业务之间的关系，在保证各投资组合既具有相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过对异常交易行为的监控、分析评估、监察稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，按照时间优先、价格优先的原则，对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合，均采用了系统中的公平交易模块进行操作，严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易。按日内、3 日内、5 日内三个不同的时间窗口，对管理人管理的全部投资组合在本报告期内的交易情况进行了同向交易价差分析，各投资组合交易过程中不存在显著的交易价差，不存在不公平交易的情况。本报告期内未发现任何违反公平交易的行为。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本集合计划各项交易均严格按照相关法律法规、本集合计划资产管理合同的有关要求执行。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年，国内经济基本面呈现弱复苏态势。在全球制造业景气修复和海外补库存的支撑下，出口增速保持较高增长；基建在财政发力稍显滞后的影响下，同比增速尚可但仍保持一定韧性；制造业持续回暖，投资增速提升明显；房地产整体仍显羸弱，需求端改善不及预期，后续

期待政策进一步加码。货币政策方面，央行维持整体流动性相对合理充裕，同时也兼顾防风险防空转等。上半年央行降准 1 次 50bp，未调降 OMO 及 MLF 利率，为后续政策操作留有空间。从十年国债收益率走势来看，1-2 月，在股市大幅走弱、资金面宽松、资产荒、银行保险强配置力量等共同作用下，收益率从 2.56% 一路下行至 2.27%；3 月-4 月中旬，在股市企稳回暖、经济数据超预期、止盈盘压力等因素下，收益率在 2.23%-2.35% 窄幅震荡。4 月中下旬在央行发文提示当前长期国债收益率与长期经济增长率不匹配的利空下，收益率从 2.23% 回升至 2.35%。5-6 月，在资金面宽松、资产荒、银行理财大幅增长、经济刺激政策相对克制等共同影响下，收益率从 2.35% 一路下行至 2.21%。

组合运作上，基于该基金产品的特性，管理人始终保持合理稳健的投资策略，精选中高等级短期信用债为底仓，适度采用杠杆策略增厚收益。根据市场走势，动态调整组合的久期和杠杆，择机参与利率债的交易，提升组合收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 A 单位净值为 1.0631 元，本报告期基金单位净值增长率为 2.27%，业绩比较基准收益率为 0.84%。申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 B 单位净值为 1.0664 元，本报告期基金单位净值增长率为 2.37%，业绩比较基准收益率为 0.84%。申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 C 单位净值为 1.0590 元，本报告期基金单位净值增长率为 2.15%，业绩比较基准收益率为 0.84%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年下半年，政府对于经济高质量增长的诉求仍将是重点，预计国内经济基本面将边际弱复苏。政府债发行预计提速，财政相对上半年将更为积极，基建投资增速将有所提升。国内通胀总体可控，货币政策上延续稳健宽松，流动性整体无忧，对于监管导向需紧密关注。地产在供需政策加码下，恢复情况仍有待观察，预计地产基本面低位寻底概率较大。消费上政策持续支持，总体韧性较高，预计维持复苏格局。出口方面，在海外需求高韧性下，仍将保持一定支撑。总体而言，经济基本面预计保持弱修复态势，货币政策稳健宽松，流动性充裕合理，债券市场表现预计相对稳定。考虑到目前债券收益率已运行至历史低位，管理人将继续基于产品的特性，择机择时优化资产配置，进一步丰富产品的投资策略，更加灵活调整组合久期和杠杆，力争为投资者获取更好的收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及集合计划合同约定，本集合计划管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了集合计划估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，

使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本集合计划托管人审阅本集合计划管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查集合计划资产净值和集合计划份额申购、赎回价格。会计师事务所对估值调整导致集合计划资产净值的变化在 0.25% 以上时所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

- 1、本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形；
- 2、本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划 2024 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资

组合报告等内容真实、准确。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	3,915,185.46	1,048,960.19
结算备付金		3,443,932.16	2,068,930.47
存出保证金		2,345.92	3,541.87
交易性金融资产	6.4.7.2	778,895,638.24	637,036,832.70
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		778,895,638.24	616,650,476.54
资产支持证券投资		-	20,386,356.16
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,846,456.65	314,875.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		788,103,558.43	640,473,140.28
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		110,515,556.55	83,128,937.43

应付清算款		3,008,878.46	2,980.83
应付赎回款		10.11	-
应付管理人报酬		99,689.35	73,163.44
应付托管费		53,395.42	47,561.26
应付销售服务费		16,786.17	10,904.10
应付投资顾问费		-	-
应交税费		45,747.22	40,741.97
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	118,159.18	315,033.66
负债合计		113,858,222.46	83,619,322.69
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	633,504,223.43	534,978,290.89
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	40,741,112.54	21,875,526.70
净资产合计		674,245,335.97	556,853,817.59
负债和净资产总计		788,103,558.43	640,473,140.28

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 633,504,223.43 份，基金资产净值（暂估业绩报酬前）674,245,335.97 元，暂估业绩报酬金额 106,172.90 元，基金资产净值（暂估业绩报酬后）674,139,163.07 元，其中申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 A 基金份额总额 197,076,083.41 份，基金资产净值 209,509,720.23 元，基金份额净值 1.0631 元。申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 B 基金份额总额 346,937,674.24 份，基金份额净值（暂估业绩报酬前）1.0664 元，基金资产净值（暂估业绩报酬前）369,965,699.56 元，暂估业绩报酬金额 106,172.90 元，基金资产净值（暂估业绩报酬后）369,859,526.66 元。申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 C 基金份额总额 89,490,465.78 份，基金资产净值 94,769,916.18 元，基金份额净值 1.0590 元。

实际计提时的业绩报酬金额可能会与此处暂估业绩报酬金额有差异。其中，基金资产净值（暂估业绩报酬后）=基金资产净值（暂估业绩报酬前）-暂估业绩报酬金额；暂估业绩报酬为假设本基金于本报告期末按照当日的基金份额净值（计提业绩报酬前）清算，根据基金份额持有人持有的基金份额（包括未到期份额）至该日止持有期间的收益情况估算的业绩报酬。该金额是各基金份额持有人的暂估业绩报酬的合计，各基金份额持有人实际应承担的业绩报酬金额根据其持有期间的实际收益情况计算确认。

## 6.2 利润表

会计主体：申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		15,973,067.28	14,176,769.04
1. 利息收入		28,133.69	29,235.24
其中：存款利息收入	6.4.7.9	28,133.69	17,943.74
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	11,291.50
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		13,131,884.59	9,814,329.31
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	12,804,463.98	9,784,006.18
资产支持证券投资收益	6.4.7.11	327,420.61	30,323.13
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	2,813,049.00	4,333,204.49
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		2,334,027.55	1,443,764.79
1. 管理人报酬		513,759.47	312,791.64
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费		296,840.50	267,354.22
3. 销售服务费		75,264.74	18,723.60
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,333,617.63	731,317.77
其中：卖出回购金融资产支出		1,333,617.63	731,317.77
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		33,289.89	29,606.64

8. 其他费用	6. 4. 7. 16	81, 255. 32	83, 970. 92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13, 639, 039. 73	12, 733, 004. 25
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13, 639, 039. 73	12, 733, 004. 25
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		13, 639, 039. 73	12, 733, 004. 25

### 6.3 净资产变动表

会计主体：申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	534, 978, 290. 89	-	21, 875, 526. 70	556, 853, 817. 59
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	534, 978, 290. 89	-	21, 875, 526. 70	556, 853, 817. 59
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	98, 525, 932. 54	-	18, 865, 585. 84	117, 391, 518. 38
（一）、综合收益总额	-	-	13, 639, 039. 73	13, 639, 039. 73
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	98, 525, 932. 54	-	5, 226, 546. 11	103, 752, 478. 65
其中：1. 基金申购款	193, 108, 064. 86	-	10, 103, 132. 38	203, 211, 197. 24
2. 基金赎回款	-94, 582, 132. 32	-	-4, 876, 586. 27	-99, 458, 718. 59
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净	-	-	-	-

资产变动（净资产减少以“-”号填列）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	633,504,223.43	-	40,741,112.54	674,245,335.97
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	533,797,564.51	-	208,353.79	534,005,918.30
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	533,797,564.51	-	208,353.79	534,005,918.30
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	24,040,731.35	-	13,281,367.30	37,322,098.65
（一）、综合收益总额	-	-	12,733,004.25	12,733,004.25
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	24,040,731.35	-	548,363.05	24,589,094.40
其中：1. 基金申购款	115,334,821.73	-	1,749,943.14	117,084,764.87
2. 基金赎回款	-91,294,090.38	-	-1,201,580.09	-92,495,670.47
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-

四、本期期末净资产	557,838,295.86	-	13,489,721.09	571,328,016.95
-----------	----------------	---	---------------	----------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>袁锦</u>	<u>袁锦</u>	<u>王一蕊</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）于 2022 年 7 月 29 日经中国证监会《关于准予宏源证券宏源 10 号股债双鑫集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2022]1350 号）批准，《申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》于 2022 年 11 月 15 日起正式变更生效。本集合计划为契约型开放式，自合同变更生效日起存续期不得超过 3 年。本集合计划的管理人为申万宏源证券有限公司，托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》的有关规定，本集合计划主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的国债、地方政府债、政府支持机构债、央行票据、金融债券（含次级债券）、政策性金融债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含分离交易可转债、可交换债券）、证券公司发行的短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、债券回购、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本集合计划不参与新股申购或增发新股，也不直接买入股票等权益类资产，但可持有因可转换债券转股和可交换债券换股形成的股票。因上述原因持有的股票应在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。

如法律法规或监管机构以后允许投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本集合计划的投资组合比例为：投资于债券的比例不低于集合计划总资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本集合计

划主动投资可转换债券及可交换债券的投资比例合计不高于资产净值的 20%。

如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种或对投资比例要求发生变更，集合计划管理人在履行适当程序后，可以相应调整本集合计划的投资范围和投资比例规定。

本集合计划的业绩比较基准为中债-新综合全价（1 年以下）指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题

的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### (2) 增值税

根据财政部和国家税务总局《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]14号)、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2号)以及《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税[2017]56号)规定，管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，自2018年1月1日(含)起，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

#### (3) 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例(2011年修订)》、《征收教育费附加的暂行规定(2011年修订)》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加(除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外)及地方教育费附加。

#### (4) 企业所得税

参照财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，对管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

参照财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### (5) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	3,915,185.46
等于：本金	3,914,694.26
加：应计利息	491.20
减：坏账准备	-

定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	3,915,185.46

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	115,782,211.56	2,787,758.25	119,662,186.25	1,092,216.44
	银行间市场	644,055,452.96	11,653,551.99	659,233,451.99	3,524,447.04
	合计	759,837,664.52	14,441,310.24	778,895,638.24	4,616,663.48
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	759,837,664.52	14,441,310.24	778,895,638.24	4,616,663.48	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本报告期末本基金未持有期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本报告期末本基金未持有黄金衍生品。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购中取得的债券。

## 6.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

## 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	30,203.86
其中：交易所市场	58.05
银行间市场	30,145.81
应付利息	-
预提费用	87,955.32
合计	118,159.18

## 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

## 申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	94,076,302.34	94,076,302.34
本期申购	129,637,686.44	129,637,686.44
本期赎回（以“-”号填列）	-26,637,905.37	-26,637,905.37
本期末	197,076,083.41	197,076,083.41

## 申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 B

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	393,096,281.92	393,096,281.92
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-46,158,607.68	-46,158,607.68
本期末	346,937,674.24	346,937,674.24

## 申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 C

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	47,805,706.63	47,805,706.63
本期申购	63,470,378.42	63,470,378.42

本期赎回（以“-”号填列）	-21,785,619.27	-21,785,619.27
本期末	89,490,465.78	89,490,465.78

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,143,692.05	571,135.20	3,714,827.25
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	3,143,692.05	571,135.20	3,714,827.25
本期利润	2,636,465.15	606,577.19	3,243,042.34
本期基金份额交易产生的变动数	4,462,962.75	1,012,804.48	5,475,767.23
其中：基金申购款	5,623,595.61	1,246,699.42	6,870,295.03
基金赎回款	-1,160,632.86	-233,894.94	-1,394,527.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,243,119.95	2,190,516.87	12,433,636.82

申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,078,906.73	2,327,313.94	16,406,220.67
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	14,078,906.73	2,327,313.94	16,406,220.67
本期利润	7,188,986.82	1,916,478.76	9,105,465.58
本期基金份额交易产生的变动数	-2,043,496.77	-440,164.16	-2,483,660.93
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-2,043,496.77	-440,164.16	-2,483,660.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,224,396.78	3,803,628.54	23,028,025.32

申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,464,386.02	290,092.76	1,754,478.78
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,464,386.02	290,092.76	1,754,478.78
本期利润	1,000,538.76	289,993.05	1,290,531.81
本期基金份额交易产生的变动数	1,821,896.39	412,543.42	2,234,439.81
其中：基金申购款	2,620,603.69	612,233.66	3,232,837.35

基金赎回款	-798,707.30	-199,690.24	-998,397.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,286,821.17	992,629.23	5,279,450.40

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入		9,969.62
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		-
结算备付金利息收入		18,149.49
其他		14.58
合计		28,133.69

#### 6.4.7.10 债券投资收益

##### 6.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
债券投资收益——利息收入		11,624,244.66
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入		1,180,219.32
债券投资收益——赎回差价收入		-
债券投资收益——申购差价收入		-
合计		12,804,463.98

##### 6.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额		397,520,465.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额		387,750,373.14
减：应计利息总额		8,577,373.06
减：交易费用		12,499.88
买卖债券差价收入		1,180,219.32

#### 6.4.7.11 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.11.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	

资产支持证券投资收益——利息收入	327,420.61
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券 差价收入	-
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	327,420.61

#### 6.4.7.11.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	20,751,671.23
减：卖出资产支持证券成本总额	20,000,000.00
减：应计利息总额	751,671.23
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	0.00

#### 6.4.7.12 衍生工具收益

##### 6.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

##### 6.4.7.13 股利收益

注：本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	2,813,049.00
股票投资	-
债券投资	2,785,049.00
资产支持证券投资	28,000.00
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动 产生的预估增值税	-
合计	2,813,049.00

#### 6.4.7.15 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

## 6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	2,982.98
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
其他	18,600.00
合计	81,255.32

## 6.4.7.17 分部报告

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本集合计划无需要披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

## 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本集合计划本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

## 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
申万宏源证券资产管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
申万宏源证券有限公司	基金管理人的股东，基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.10.1.1 股票交易

注：本报告期及上年度可比期间内，本集合计划均未通过关联方交易单元进行股票交易。

## 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)

申万宏源证券有限公司	35,788,218.85	100.00	44,984,100.00	100.00
------------	---------------	--------	---------------	--------

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
申万宏源证券有限公司	2,967,475,000.00	100.00	988,100,000.00	100.00

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本报告期及上年度可比期间内，本集合计划均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
申万宏源证券有限公司	544.19	100.00	58.05	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
申万宏源证券有限公司	1,137.84	100.00	70.00	100.00

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	513,759.47
其中：应支付销售机构的客户维护费	235,270.00	0.47
应支付基金管理人的净管理费	278,489.47	312,791.17

注：本集合计划 A 类、C 类计划份额的固定管理费分别按前一日该类计划份额的集合计划资产净值的 0.3% 年费率计提，B 类计划份额的固定管理费按前一日该类计划份额的集合计划资产净值的

0.1%年费率计提。各类计划份额的固定管理费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{各类计划份额年固定管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类计划份额应计提的集合计划固定管理费

E 为前一日该类计划份额的集合计划资产净值

集合计划固定管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

集合计划管理人对本集合计划 B 类计划份额提取业绩报酬，A 类、C 类计划份额不提取业绩报酬。

对于 B 类计划份额，本集合计划采用逐笔计提法提取业绩报酬，若单个集合计划份额持有人的单笔份额在其持有期间的年化收益率超过业绩报酬计提基准（4%）时，按照超过业绩报酬计提基准部分的 20%提取业绩报酬。本集合计划业绩报酬在集合计划份额持有人赎回/转出集合计划份额或集合计划合同终止清算时收取。

#### （1）计提起始日

业绩报酬计提起始日为集合计划合同生效日。

#### （2）计提基准日

集合计划份额持有人申请赎回或转出集合计划份额时，计提基准日为集合计划份额持有人提出申请赎回或转出集合计划份额的工作日；集合计划合同终止时，计提基准日为集合计划最后运作日。

#### （3）计提基准及比例

本集合计划业绩报酬计提基准为 4%，业绩报酬计提比例为超过业绩报酬计提基准部分的 20%。因法律法规、监管政策调整而需要修订业绩报酬计提基准和计提比例的，无需召开集合计划份额持有人大会。

#### （4）计提方式

在集合计划份额持有人申请赎回或转出集合计划份额时，业绩报酬从赎回款项或转出金额中计提；在集合计划合同终止时，业绩报酬从集合计划合同终止清算资金中计提。

#### （5）业绩报酬计算方式

$$\text{业绩报酬} = \max \{ Q \times P \times [(P1 - P0) / P \times 365 / T - 4\%] \times 20\% \times T / 365, 0 \}$$

其中：

Q：应计提业绩报酬的集合计划份额数量

P1：应计提业绩报酬的集合计划份额在计提基准日的集合计划份额累计净值

P0：应计提业绩报酬的集合计划份额在计提起始日的集合计划份额累计净值

P：应计提业绩报酬的集合计划份额在计提起始日的集合计划份额净值

T：应计提业绩报酬的集合计划份额在业绩报酬计提周期内的实际持有自然天数（即集合计划合同生效日（含）至赎回/转出/终止清算确认日（不含）间的自然天数）

业绩报酬按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位。因取值精度原因，实际业绩报酬计提结果以登记机构计算结果为准。因涉及相关数据，集合计划管理人的业绩报酬的计算和复核工作由集合计划管理人完成，相关信息以登记机构计算结果为准。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	296,840.50	267,354.22

注：本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期			
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
获得销售服务费的各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 A	申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 B	申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 C	合计
申万宏源证券有限公司	-	-	66,024.55	66,024.55
中国光大银行股份有限公司	-	-	193.52	193.52
合计	-	-	66,218.07	66,218.07
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
获得销售服务费的各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费			

	申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债 券 A	申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债 券 B	申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债 券 C	合计
申万宏源证券有限 公司	-	-	17,250.63	17,250.63
合计	-	-	17,250.63	17,250.63

注：销售服务费可用于本集合计划市场推广、销售以及份额持有人服务等各项费用。本集合计划 A、B 类计划份额不收取销售服务费，C 类计划份额的销售服务费年费率为 0.3%。C 类计划份额的销售服务费按前一日 C 类计划份额资产净值的 0.3% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类集合计划份额应计提的销售服务费

E 为 C 类集合计划份额前一日的集合计划资产净值

集合计划销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

销售服务费的优惠活动以管理人相关公告为准。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本报告期及上年度可比期间内，本基金均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本报告期及上年度可比期间内，本基金均未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本报告期及上年度可比期间内，本基金均未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：根据《关于申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划管理人及自有资金跟投主体变更的公告》，自 2023 年 10 月 9 日起，本集合计划管理人由“申万宏源证券有限公司”变更为“申万宏源证券资产管理有限公司”。本报告期内，申万宏源证券资产管理有限公司无自有资金投资于本集合计划。

**6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

份额单位：份

## 申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 B

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)
申万宏源 证券有限 公司	-	-	14,900,000.00	3.7904

注：根据《申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划母公司自有资金退出公告》，申万宏源证券有限公司持有的全部份额共计 14,900,000.00 份已于 2024 年 4 月 22 日全部赎回。申万宏源证券有限公司上年度末持有的本基金份额占 B 类基金总份额比例为 3.7904%，上年度末持有的本基金份额占 A 类、B 类、C 类基金合计总份额比例为 2.7852%。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份 有限公司	3,915,185.46	9,969.62	827,136.65	11,817.11

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本报告期及上年度可比期间内，本基金均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

注：根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：本集合计划无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 68,013,972.60 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
170210	17 国开 10	2024 年 7 月 1 日	106.60	100,000	10,659,761.64
210218	21 国开 18	2024 年 7 月 1 日	102.17	100,000	10,216,795.08
210313	21 进出 13	2024 年 7 月 1 日	102.21	100,000	10,221,229.51
220208	22 国开 08	2024 年 7 月 1 日	102.32	102,000	10,436,695.89
230203	23 国开 03	2024 年 7 月 1 日	103.85	100,000	10,385,295.08
230208	23 国开 08	2024 年 7 月 1 日	102.20	100,000	10,219,545.21
240203	24 国开 03	2024 年 7 月 1 日	102.08	100,000	10,207,693.99
合计				702,000	72,347,016.40

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 42,501,583.95 元，最晚于 2024 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划是一只债券型集合资产管理计划，主要面临的金融工具风险包括：信用风险、流动性风险和市场风险，其中市场风险部分主要是利率风险。管理人制定了管理机制和监控指标来识别及分析这些风险，并针对各风险类型设定适当的风险限额及内部控制流程。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，遵循申万宏源证券资产管理有限公司的风险管理架构，将风险管理融入业务中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。建立的风险管理体系由三道风险防范层级构成。一道风险防范层级是指公司经营管理层下设风险管理委员会，负责公

司风险的控制、管理、监督和评价；二道风险防范层级是指公司下设风险管理部及信评部门对资产管理业务风险进行的预防和控制；三道风险防范是指投资部门对自身业务工作风险进行的自我检查和控制。各部门负责人为其所在部门风险管理的第一责任人，公司员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。风险管理部门对公司的风险管理进行独立评估、监控、检查并及时向管理层汇报。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人建立了信用风险评估与管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制信用风险，通过分散化投资以分散信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部信用评级体系全面考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险、信用产品的条款和担保人的情况等。

本集合计划在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本集合计划在进行银行间同业市场交易均通过事前检查和控制对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本集合计划报告期末债券投资按短期信用评级及长期信用评级列示的情况如下，其中不包括本集合计划所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	0.00	5,155,393.44
A-1 以下	0.00	-
未评级	72,234,374.31	96,996,679.78
合计	72,234,374.31	102,152,073.22

注：本表主要列示短期融资券和超短期融资券，债券评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券列示其他短期融资券和超短期融资券。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本期末及上年度末均不涉及。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本期末及上年度末均不涉及。

## 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	287,242,137.37	200,502,841.83
AAA 以下	132,289,254.94	83,383,914.32
AA+	132,289,254.94	83,383,914.32
未评级	56,911,651.55	56,832,088.90
合计	476,443,043.86	340,718,845.05

注：本表主要列示除短融和超短融之外的信用债，债券评级取自第三方评级机构的最新债项评级。

## 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	0.00	20,386,356.16
AAA 以下	0.00	-
-	0.00	-
未评级	0.00	-
合计	0.00	20,386,356.16

## 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	39,559,587.92	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	39,559,587.92	0.00

## 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指管理人未能以合理价格及时变现集合计划资产以支付投资者赎回款项的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于份额持有人可随时要求赎回其持有的集合计划份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对第一类兑付赎回资金的流动性风险，管理人已经建立针对本集合计划申购赎回状况的监控和预测机制以及巨额赎回审批规程，对于巨额赎回建立严格的流动性评估机制；同时在资产管理合同约定巨额赎回条款，明确巨额赎回资金的处理模式，有效保障持有人利益。

针对第二类投资品种的流动性风险，管理人持续监控各项流动性指标，包括组合持仓集中度、投资组合在短时间内变现能力、流通受限资产的比例等指标，通过指标来持续地评估、选择、跟

踪和控制投资组合的投资流动性风险。管理人已建立压力测试机制，针对不同类型投资组合建立流动性压力测试模型，对各相关风险因子进行极端假设，进而评估对投资组合流动性的负面影响。同时，建立流动性风险应急机制，在发生或发现潜在较大的流动性风险时，管理人会立即启动应急机制。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理。

本基金管理人采用监控集合计划组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、集合计划组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本集合计划的申购赎回情况进行监控，保持集合计划投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本集合计划资产的变现能力与投资者赎回需求相匹配。

本基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度。通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等方面进行尽职调查，严格落实准入管理；对交易对手实施交易额度管理等措施来管理本集合计划从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。

综合上述各项流动性指标的监测结果、流动性风险管理措施的实施以及本集合计划的资产和负债情况，本集合计划本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指集合计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指集合计划的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本集合计划的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

管理人通过由风险管理人员定期监控组合的利率敏感性缺口，对利率水平进行分析和预测，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,915,185.46	-	-	-	3,915,185.46
结算备付金	3,443,932.16	-	-	-	3,443,932.16
存出保证金	2,345.92	-	-	-	2,345.92
交易性金融资产	321,399,637.20	291,335,634.95	166,160,366.09	-	778,895,638.24
应收申购款	-	-	-	1,846,456.65	1,846,456.65
资产总计	328,761,100.74	291,335,634.95	166,160,366.09	1,846,456.65	788,103,558.43
负债					
应付赎回款	-	-	-	10.11	10.11
应付管理人报酬	-	-	-	99,689.35	99,689.35
应付托管费	-	-	-	53,395.42	53,395.42
其他负债	-	-	-	118,159.18	118,159.18
应付清算款	-	-	-	3,008,878.46	3,008,878.46
卖出回购金融资产款	110,515,556.55	-	-	-	110,515,556.55
应付销售服务费	-	-	-	16,786.17	16,786.17
应交税费	-	-	-	45,747.22	45,747.22
负债总计	110,515,556.55	-	-	3,342,665.91	113,858,222.46
利率敏感度缺口	218,245,544.19	291,335,634.95	166,160,366.09	-1,496,209.26	674,245,335.97
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,048,960.19	-	-	-	1,048,960.19
结算备付金	2,068,930.47	-	-	-	2,068,930.47
存出保证金	3,541.87	-	-	-	3,541.87
交易类债券投资	262,290,515.21	265,711,033.46	88,648,927.87	-	616,650,476.54
交易性资产支持证券	20,386,356.16	-	-	-	20,386,356.16
应收申购款	-	-	-	314,875.05	314,875.05
资产总计	285,798,303.90	265,711,033.46	88,648,927.87	314,875.05	640,473,140.28
负债					
卖出回购金融资产款	83,128,937.43	-	-	-	83,128,937.43
应付证券清算款	-	-	-	2,980.83	2,980.83
应付管理人报酬	-	-	-	73,163.44	73,163.44
应付托管费	-	-	-	47,561.26	47,561.26
应付销售服务费	-	-	-	10,904.10	10,904.10
应交税费	-	-	-	40,741.97	40,741.97
其他负债	-	-	-	315,033.66	315,033.66
负债总计	83,128,937.43	-	-	490,385.26	83,619,322.69
利率敏感度缺口	202,669,366.47	265,711,033.46	88,648,927.87	-175,510.21	556,853,817.59

注：上表统计了本集合计划的利率风险敞口。表中所示为本集合计划资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	5,339,179.85	3,067,015.54
2. 市场利率上升 25 个基点	-5,339,179.85	-3,067,015.54	

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票和债券等资产损失的可能性。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日

第一层次	3,198,082.66	2,153,377.26
第二层次	775,697,555.58	634,883,455.44
第三层次	-	-
合计	778,895,638.24	637,036,832.70

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。本基金本报告期及上年度可比期间持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本集合计划持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	778,895,638.24	98.83
	其中：债券	778,895,638.24	98.83
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,359,117.62	0.93
8	其他各项资产	1,848,802.57	0.23
9	合计	788,103,558.43	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本集合计划本报告期期末未投资股票。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票资产。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本集合计划本报告期期末未投资股票。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本集合计划本报告期期末未投资股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本集合计划本报告期期末未投资股票。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	14,844,152.88	2.20
2	央行票据	-	-
3	金融债券	175,814,479.27	26.08
	其中：政策性金融债	165,597,684.19	24.56
4	企业债券	125,962,337.21	18.68
5	企业短期融资券	72,234,374.31	10.71
6	中期票据	218,364,764.76	32.39
7	可转债（可交换债）	3,198,082.66	0.47
8	同业存单	39,559,587.92	5.87
9	其他	128,917,859.23	19.12
10	合计	778,895,638.24	115.52

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	092280108	22 中行二级资本债 02A	350,000	36,688,606.56	5.44
2	042380375	23 东楚投资 CP001	300,000	31,425,491.80	4.66
3	102101064	21 赣州开投	300,000	31,202,721.31	4.63

		MTN002			
4	240205	24 国开 05	300,000	31,181,254.10	4.62
5	190311	19 进出 11	300,000	30,876,565.57	4.58

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.10.1 本期国债期货投资政策

本集合计划对国债期货的投资根据风险管理原则，以套期保值为目的。结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，获取超额收益。

#### 7.10.2 本期国债期货投资评价

本报告期本基金无国债期货交易。

### 7.11 投资组合报告附注

#### 7.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、国家开发银行、中国进出口银行、兴业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、中国人民银行、银保监会的处罚。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

除此之外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚的情形。

#### 7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金本报告期不涉及股票投资。

#### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,345.92
2	应收清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	1,846,456.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,848,802.57

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110059	浦发转债	3,198,082.66	0.47

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期不涉及股票投资。

#### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 A	667	295,466.39	41,098,700.30	20.85	155,977,383.11	79.15
申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 B	781	444,222.37	45,160,000.00	13.02	301,777,674.24	86.98
申万宏源季季优选 3 个月滚	466	192,039.63	6,214,793.39	6.94	83,275,672.39	93.06

动持有债券 C						
合计	1,914	330,984.44	92,473,493.69	14.60	541,030,729.74	85.40

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 A	0.00	0.0000
	申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 B	0.00	0.0000
	申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 C	979.62	0.0011
	合计	979.62	0.0002

注：本报告期末基金管理人所有从业人员持有本基金份额占 C 类基金总份额比例为 0.0011%，占 A 类、B 类、C 类基金合计总份额比例为 0.0002%。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 A	0
	申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 B	0
	申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 A	0
	申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 B	0
	申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 A	申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 B	申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券 C
基金合同生效日（2022 年 11 月 15 日）基金份额总额	-	708,811,304.58	-
本报告期期初	94,076,302.34	393,096,281.92	47,805,706.63

基金份额总额			
本报告期基金总申购份额	129,637,686.44	-	63,470,378.42
减：本报告期基金总赎回份额	26,637,905.37	46,158,607.68	21,785,619.27
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	197,076,083.41	346,937,674.24	89,490,465.78

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本集合计划未召开份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，管理人高级管理人员变动情况如下：

- (1) 2024 年 1 月 2 日起，王伟同志担任总经理助理；
- (2) 2024 年 2 月 2 日，免去李琦同志总经理职务；
- (3) 2024 年 2 月 2 日起，袁锦同志担任总经理，免去副总经理职务；
- (4) 2024 年 2 月 2 日，免去唐卫江同志董事会秘书职务；
- (5) 2024 年 2 月 2 日起，财务总监叶枫同志兼任董事会秘书；
- (6) 2024 年 4 月 12 日，免去姜山同志副总经职务；
- (7) 2024 年 5 月 23 日，免去吴惧同志总经理助理职务。

本报告期内，管理人董事变动情况如下：

- (1) 2024 年 01 月 19 日起，袁锦同志担任董事；
- (2) 2024 年 2 月 2 日起，李琦同志担任董事长；
- (3) 2024 年 04 月 19 日起，王胜同志担任董事，周海晨同志不再担任董事职务。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

无。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未发生改聘会计师事务所事宜。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
申万宏源证券有限公司	2	-	-	544.19	100.00	-

注：交易单元选择的标准：1、经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；2、公司财务状况良好；3、有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；4、有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；5、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。本报告期内本基金租用券商交易单元无变更。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
申万宏源证券有限公司	35,788,218.85	100.00	2,967,475.00 0.00	100.00	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	申万宏源证券资产管理有限公司基金	中国证监会规定披露媒	2024 年 1 月 3 日

	行业高级管理人员变更公告	介	
2	申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划新增销售机构的公告	中国证监会规定披露媒介	2024 年 1 月 4 日
3	申万宏源证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定披露媒介	2024 年 2 月 2 日
4	申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划新增销售机构的公告	中国证监会规定披露媒介	2024 年 3 月 1 日
5	申万宏源证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定披露媒介	2024 年 4 月 12 日
6	申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划母公司自有资金退出公告	中国证监会规定披露媒介	2024 年 4 月 19 日
7	申万宏源证券资产管理有限公司关于董事变更的公告	中国证监会规定披露媒介	2024 年 4 月 23 日
8	申万宏源证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定披露媒介	2024 年 5 月 23 日
9	申万宏源证券资产管理有限公司住所变更公告	中国证监会规定披露媒介	2024 年 5 月 23 日
10	申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划（A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定披露媒介	2024 年 5 月 31 日
11	申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划（B 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定披露媒介	2024 年 5 月 31 日
12	申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划（C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定披露媒介	2024 年 5 月 31 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，未发现影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 2、《申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议》；

- 3、《申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》；
- 4、《申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划基金产品资料概要》；
- 5、管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

## 12.2 存放地点

上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层

## 12.3 查阅方式

投资者可到管理人、托管人的办公场所或管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：95523

公司网址：[www.swhyzcgl.com](http://www.swhyzcgl.com)

申万宏源证券资产管理有限公司

2024 年 8 月 30 日